

UNIVERSITÄT DORTMUND

Wintersemester 2007/08

Praktische Optimierung
(Vorlesung)

Prof. Dr. Günter Rudolph
Fachbereich Informatik
Lehrstuhl für Algorithm Engineering

Kapitel 1: Einleitung

Arbeitsdefinition:
Praktische Optimierung =_{def}
Was kann man tun, wenn

1. Problem nicht analytisch lösbar und
2. kein Lösungsalgorithmus bekannt.

⇒ Zu behandelnde **Fragestellungen:**

- Wie löst man Probleme analytisch?
- Welche Verfahren für bestimmte Problemklassen gibt es?
- Wie entwickelt man ein (heuristisches) Verfahren zur approximativen Lösung?

Rudolph: PO (WS 2007/08) • Kap. 1: Einleitung 2

Kapitel 1: Einleitung

Problemklassen

hier:

- deterministisch, statisch
- deterministisch, statisch, ≥ 2 Zielsetzungen
- nicht-deterministisch, statisch
- deterministisch, dynamisch

Rudolph: PO (WS 2007/08) • Kap. 1: Einleitung 3

Kapitel 1: Einleitung

Statisch, deterministisch

$f(x; \theta) \rightarrow \min!$
↑
Parameter $\in \mathbb{R}^p$

statisch	: keine Änderungen über der Zeit
deterministisch	: alle Parameter sind Konstanten

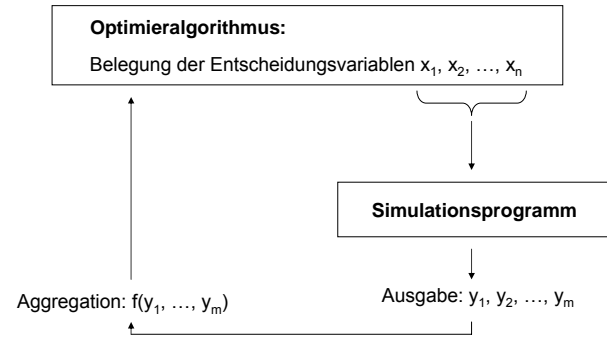
1. **Ansatz:** Analytisch lösbar? $f(\cdot)$ differenzierbar? Lösung herleitbar?

iterative Näherung? $x^{(t+1)} = \text{ALG}(x^{(t)})$

Berechnung von $f(\cdot)$ kann viel Zeit kosten!
z.B. bei technischen Anwendungen: Simulationslauf

Rudolph: PO (WS 2007/08) • Kap. 1: Einleitung 4

Kapitel 1: Einleitung



denkbar: „Metamodellierung“ von $f(\cdot)$

Idee: erzeuge approximatives Modell von $f(\cdot)$, das schnell zu berechnen!

Kapitel 1: Einleitung

mehrfache Zielsetzung:

Beispiel: Brennstabwechselproblem (1994f.):

A565	A321	0232	B121	D099	A111	A121
A226	0321	C139	A982	C321	C021	A222
A987	A553	B111	B112	A002	A144	0128
A009	B454	0287	A801	B071	B522	
C343	D762	C424	0999	B991		
0292	D393	A632	0020			
A233	B987	C112				

gleichmäßiger Abbrand → max.

hohe Energieleistung → max.

heiße / aktive Stäbe
kalte / inaktive Stäbe

Brennstabauswahl, -position und -orientierung → Simulator

Simulator rechnet ... (damals ca. 60s) → Ausgabe: 2 Werte

Kapitel 1: Einleitung

mehrfache Zielsetzung:

Was bedeutet hier „optimal“?

1 Ziel : Lösung x^* , so dass $f(x^*)$ kleinster/größter Wert

2 Ziele : Lösung x^* , so dass $f(x^*)$... ?

Problem: unvergleichbare Lösungen

Bsp: $\begin{pmatrix} 3 \\ 6 \end{pmatrix} \preceq \begin{pmatrix} 4 \\ 7 \end{pmatrix}$ und $\begin{pmatrix} 3 \\ 6 \end{pmatrix} \preceq \begin{pmatrix} 3 \\ 7 \end{pmatrix}$ aber $\begin{pmatrix} 3 \\ 6 \end{pmatrix} \parallel \begin{pmatrix} 2 \\ 7 \end{pmatrix}$

⇒ neuer Optimalitätsbegriff nötig!

⇒ Pareto-Optimalität

Kapitel 1: Einleitung

Was tun, wenn Physik / Chemie etc. des Prozesses unverstanden?

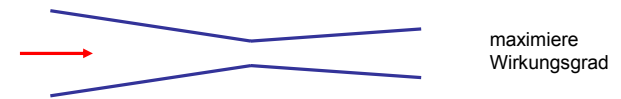
⇒ kein Simulationsprogramm verfügbar!

Ansatz:

Optimierung am realen Objekt!

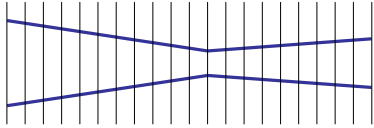
Beispiel: Zweiphasendüse (Schwefel, 1968)

Hochgeschwindigkeitdüse, turbulente Strömung, physikalisch nicht modellierbar



Kapitel 1: Einleitung

Versuchsaufbau:

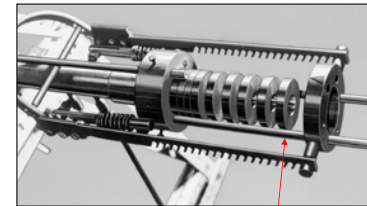


Herstellung verschiedener konisch geformter Teilstücke / Segmente
Form des Düsenteilstücks ist Entscheidungsvariable

Auswahl von Düsenteilstücken
Zusammenspannen
Wasserdampf unter hohem Druck durch Düse
Wirkungsgrad **messen!** } „Simulatorersatz“

Kapitel 1: Einleitung

Das reale Objekt:



Segment

Startlösung:



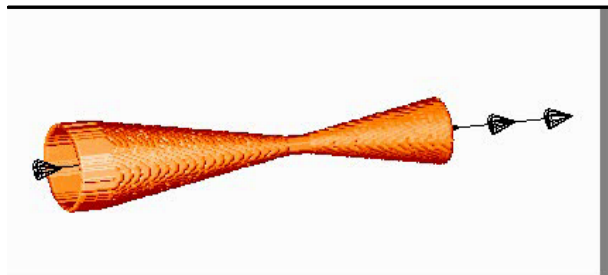
Optimierte Lösung:

(nach 45 Verbesserungen)



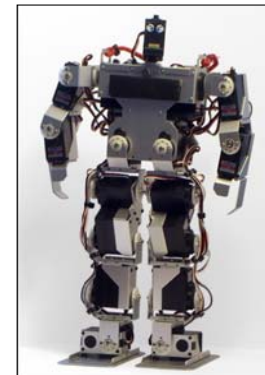
Kapitel 1: Einleitung

Video:



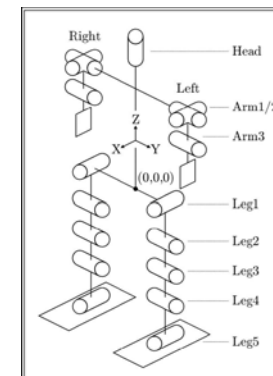
Kapitel 1: Einleitung

Neueres Beispiel: Humanoider Roboter soll laufen lernen!



Kondo KHR-1

Modell:



Kapitel 1: Einleitung

Ansatz:

- Physikalisches Modell des Laufens aufstellen
Parametrisiert: Wie hoch Fuß heben? Wie weit Arm schwingen? etc.
- Simulationsprogramm („Walking Engine“)
- Optimalalgorithmus variiert **Parameter**
- Optimalitätskriterium: Laufgeschwindigkeit (aus Simulation)

Nach Optimierung:

Parameter in den realen Roboter laden ...

... und er fällt um, läuft schief, läuft langsam.



Warum?
Modell und
Simulation zu
ungenau!

Kapitel 1: Einleitung



Lichtschranken

Aufbau:

1. Optimierer variiert Parameter
2. Download zum Robo
3. Läuft ...
4. Qualität = Zeit zwischen Lichtschranken

Kapitel 1: Einleitung

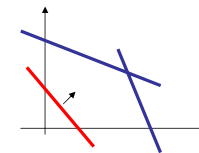


© Ralf Kosse: Diplomarbeit, Uni Dortmund, FB Informatik, IRF + LS11, September 2006.

Kapitel 1: Einleitung

Was ist zu beachten, wenn Parameter des Problems **stochastisch**?

$$f(x) = c_1 x_1 + c_2 x_2 \quad \text{mit } A \cdot x \leq b$$



$$f(x) = z = \text{const.}$$

- Wenn c_i in $f(\cdot)$ Zufallsvariable (Zva):
⇒ $f(\cdot)$ Zva
⇒ Steigung zufällig

- Wenn Parameter in A und/oder b Zva:
⇒ zulässiger Bereich zufällig
⇒ zulässige (ggf. optimale) Lösung wird unzulässig!

Optimalitätsbegriff?



Was kann man tun, wenn Parameter **zeitabhängig**?

⇒ das Optimum wandert im Raum!

- Optimum folgen ...
- Optimum vorhersagen ...

Optimalitätsbegriff?